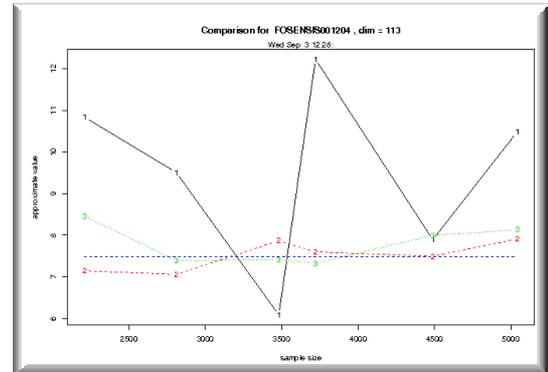


Monte-Carlo-Verfahren

Unsere Leistungen

Im Team ist vielseitige Kompetenz bei der Analysis und Implementation von Monte-Carlo- und quasi-Monte-Carlo-Verfahren in verschiedenen Anwendungsgebieten vorhanden. Dies ermöglicht die Auswahl des für die jeweilige Situation besonders geeigneten Verfahrens. In vielen Fällen können beweisbare Fehlerschranken für die Performance der eingesetzten Verfahren gegeben werden.



Vergleich verschiedener Monte-Carlo-Verfahren

Anwendungsgebiete

Im Finance gewinnen Simulationen immer dann an Bedeutung, wenn komplexe Modelle den Einsatz herkömmlicher Verfahren unmöglich machen, beziehungsweise diese einen unverhältnismäßigen Aufwand erfordern. Dies ist der Fall bei:

- Vorhersage/Bewertung komplexer Portfolios,
- Bewertung komplizierter und exotischer Derivate und bei der Bestimmung des *VaR* oder anderer, *kohärenter* Maße zur Bewertung von Risiken.

Ihr Vorteil

Wir können Ihnen Algorithmen bieten, die dem jeweiligen Problem angepasst und effizient sind. Unter Verwendung von verschiedenen Strategien zur Varianzreduktion, insbesondere

- Stratifizierung,
- Importance Sampling, auch dynamisch und
- preconditioning durch deterministische Verfahren,

und objektorientierter Implementation, bekommen Sie Verfahren an die Hand, die den internationalen Standards entsprechen oder darüber hinausgehen.